广发纳斯达克100指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发纳斯达克100指数 (QDII)
基金主代码	270042
交易代码	270042
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年8月15日
报告期末基金份额总额	147,112,950.56份
投资目标	本基金采用被动式指数化投资策略,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力求实现对标的指数的有效跟踪,追求跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金以追求标的指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的双重约束下构建指数化的投资组合。 本基金力争控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度小于0.5%,基金净值增长率与业绩比较基准之间的年跟踪误差不超过5%。 本基金对纳斯达克100指数成份股的投资比例不低于基金资产净值的85%,对纳斯达克100指数备选成份股及以纳斯达克100指数为投资标的的交易型开放式指数基金(ETF)的投资比例不高于基金资产净值的10%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。 本基金主要采用完全复制法,即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。 当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。 本基金将主要以降低跟踪误差和投资组合流动性管理为目的,综合考虑流动性和政益性,构建本基金债券和货币市场工具的投资组合。
业绩比较基准	人民币计价的纳斯达克100总收益指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数,其有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	Bank of China(Hong Kong)
境外资产托管人中文名称	中国银行(香港)有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	8,639,706.29
2.本期利润	30,449,946.53
3.加权平均基金份额本期利润	0.2135
4.期末基金资产净值	245,608,331.68
5.期末基金份额净值	1.670

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

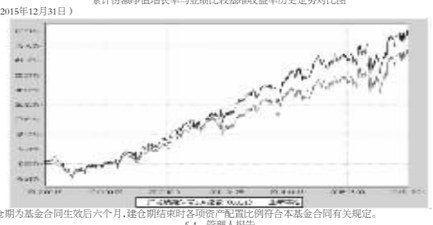
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	14.31%	1.13%	12.45%	1.14%	1.86%	-0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发纳斯达克100指数证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012年8月15日至2015年12月31日)



注:本基金建仓期为基金合同生效后六个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邱炜	本基金的基金经理;广发全球农业指数 (QDII) 基金的基金经理;广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理;广发亚太中高收益债券 (QDII) 基金的基金经理;广发全球医疗保健 (QDII) 基金的基金经理;广发生物科技指数 (QDII) 基金的基金经理;广发纳斯100ETF基金的基金经理;国际业务部副总经理;另类投资部副总经理	2012-08-15	-	8年	男,中国籍,统计学博士,持有中国证券投资基金业从业证书。2007年5月至2008年7月在摩根大通集团(现约瑟夫氏高分析师兼助理副总裁。2008年7月至2011年6月任广发基金管理有限公司国际业务部研究员。2011年6月28日起任广发全球农业指数(QDII)基金的基金经理。2012年8月15日起任广发纳斯达克100指数(QDII)基金的基金经理。2013年8月9日起任广发美国房地产指数(QDII)基金的基金经理。2013年11月28日起任广发亚太中高收益债券(QDII)基金的基金经理。2013年12月10日起任广发全球医疗保健(QDII)基金的基金经理。2014年1月21日起任广发基金管理有限公司国际业务部副总经理。2015年1月14日起任广发基金管理有限公司另类投资部副总经理。2015年3月30日起任广生物科技指数(QDII)基金的基金经理。2015年6月10日起任广发纳指100ETF基金的基金经理。
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制司通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核司通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合未发生过同日反向交易的情况。

4.4报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

经历过三季度的腥风血雨之后,美股终于在四季度迎来了反弹。10月初公布的非农就业数据是这次反弹的导火索。当时,9月新增非农就业人口仅14.2万人,显著低于市场预期的20.1万,市场对于美联储首次加息大幅延后推动美国股市以及其他地区股市的反弹。随后10月中后旬,欧洲和中国央行都释放宽松信号,美国股市继续保持强势,进入11月,强劲的非农就业数据引发大家对加息的担忧,美国股市承压,涨幅变缓。同时11月中旬的巴黎恐怖袭击事件让市场波动加大,12月份,美联储最终在当月FOMC会议上决定加息25个基点,正式开启了加息周期。美国股市在加息后,迎来了短暂的上涨后小幅回调结束了2015年的行情。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金的净值增长率为14.31%,同期业绩比较基准收益率为12.45%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年,美国以及全球市场的波动会增加,中国经济转型和美国加息的节奏将是2016年全年的主题。我们认为在这两个宏观因素的叠加下,美国股市将会表现波动,板块的结构性机会会比整体的趋势性机会要大,纳斯达克100指数仍然代表美国最先进技术,该指数的成分股受益于虚拟现实、增强现实、云计算、人工智能、新能源汽车和医药生物技术等板块的快速增长,企业的盈利仍然会进入快速上升通道,未来长期仍然有巨大的增长机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	198,434,733.53	70.87
	其中:普通股	194,385,564.51	69.43
	存托凭证	4,049,169.02	1.45
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	11,577,602.30	4.13
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	0.00	0.00
	其中:远期	-	-
	期货	0.00	0.00
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	27,577,464.24	9.85
8	其他各项资产	42,401,232.17	15.14
9	合计	279,991,032.24	100.00

5.2报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	198,434,733.53	80.79
合计	198,434,733.53	80.79

注:1.国家(地区)类别根据股票及存托凭证所在的证券交易所确定。

2.上述美国比重包括注册地为开曼群岛、英国在美国上市的ADR。

5.3报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-
材料	-	-
工业	2,951,181.26	1.20
非必须消费品	41,009,647.08	16.70
必须消费品	13,560,774.56	5.52
保健	29,189,836.24	11.88
金融	-	-
信息技术	109,544,726.01	44.60
电信服务	2,178,568.38	0.89
公共事业	-	-
合计	198,434,733.53	80.79

注:以上分类采用全球行业分类标准(GICS)。

5.4报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证投资明细

序号	公司名称(英文)	公司名称(中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量(股)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	APPLE INC	苹果公司	AAPL US	纳斯达克证券交易所	美国	32,259.00	22,049,553.48	8.98
2	MICROSOFT CORP	微软	MSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	46,219.00	16,651,084.71	6.78
3	AMAZON.COM INC	亚马逊公司	AMZN US	纳斯达克证券交易所	美国	2,712.00	11,902,857.63	4.85
4	ALPHABET INC-CL C	Alphabet公司	GOOG US	纳斯达克证券交易所	美国	1,999.00	9,850,798.47	4.01
5	FACEBOOK INC-A	Facebook公司	FB US	纳斯达克证券交易所	美国	13,137.00	8,928,170.25	3.64
6	ALPHABET INC-CL A	Alphabet公司	GOOGL US	纳斯达克证券交易所	美国	1,686.00	8,517,816.55	3.47
7	INTEL CORP	英特尔公司	INTC US	纳斯达克证券交易所	美国	27,305.00	6,108,251.92	2.49
8	GILEAD SCIENCES INC	吉利德科学	GILD US	纳斯达克证券交易所	美国	8,339.00	5,479,451.70	2.23
9	CISCO SYSTEMS INC	思科	CSCO US	纳斯达克证券交易所	美国	29,371.00	5,179,097.37	2.11
10	COMCAST CORP-CLASS A	康卡斯特	CMCSA US	纳斯达克证券交易所	美国	14,129.00	5,177,343.84	2.11

5.5报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

序号	衍生品类别	衍生品名称	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	股指期货	NASDAQ 100 E-mmi Mar16	0.00	0.00
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-
-	-	-	-	-

5.9报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
1	PROSHARES ULTRA QQQ	ETF	契约型开放式	ProShares Trust	11,577,602.30	4.71
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-

5.10投资组合报告附注

5.10.1根据公开市场信息,本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.10.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	8,026,213.11
3	应收股利	90,476.04
4	应收利息	1,056.46
5	应收申购款	2,242,491.56
6	其他应收款	32,040,995.00
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	42,401,232.17

5.10.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	149,846,945.91
本报告期基金总申购份额	27,138,907.61
减:本报告期基金总赎回份额	29,872,902.96
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	147,112,950.56

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

1.中国证监会批准广发纳斯达克100指数证券投资基金募集的文件

2.《广发纳斯达克100指数证券投资基金基金合同》

3.《广发基金管理有限公司开放式基金业务规则》

4.《广发纳斯达克100指数证券投资基金托管协议》

5.法律意见书

6.基金管理人业务资格批件、营业执照

7.基金托管人业务资格批件、营业执照

8.存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00,投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

投资者如对本报告有疑问,可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司,咨询电话95105828或020-83936999,或发电子邮件:services@gf-funds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一六年一月二十日

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月15日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	广发中证全指可选消费ETF
场内简称	可选消费
基金主代码	159936
交易代码	159936
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2014年6月3日
报告期末基金份额总额	272,156,094.00份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法,即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份及备选成份股的比例不低于基金资产净值的95%。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证全指可选消费指数。
风险收益特征	本基金为股票型基金,风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期 (2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	-13,196,793.57
2.本期利润	106,183,656.98
3.加权平均基金份额本期利润	0.3785
4.期末基金资产净值	500,420,011.04
5.期末基金份额净值	1.8387

注:(1)所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

(2)本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

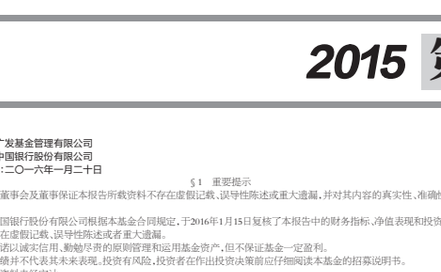
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	24.94%	1.79%	26.76%	1.84%	-1.82%	-0.05%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年6月3日至2015年12月31日)



§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆志明	本基金的基金经理;广发中小板300ETF及联接基金的基金经理;广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理;广发中证全指信息技术ETF及联接基金的基金经理;广发中证全指能源ETF基金的基金经理;广发可选消费联接基金的基金经理;广发医药卫生联接基金的基金经理;广发信息技术联接基金的基金经理;广发中证全指能源联接基金的基金经理;广发中证全指原材料ETF基金的基金经理;广发中证全指非银行金融ETF基金的基金经理;广发可选消费联接基金的基金经理;广发能源联接基金的基金经理;广发金融地产联接基金的基金经理;广发医疗指数分级基金的基金经理;广发原材料联接基金的基金经理;广发非银行金融联接基金的基金经理;广发医疗联接基金的基金经理;广发证券指数分级基金的基金经理	2014-06-03	-	16年	男,中国籍,经济学硕士,持有中国证券投资基金业从业证书。1999年5月至2001年5月在大鹏证券有限公司任研究员。2001年4月至2010年8月在深圳证券信息有限公司任部门经理。2010年8月9日至今任广发基金管理有限公司数量投资部总经理。2011年6月3日起任广发中小板300ETF基金的基金经理。2011年6月9日起任广发中小板300ETF联接基金的基金经理。2012年5月7日起任广发深证100指数分级基金的基金经理。2014年6月3日起任广发中证全指可选消费ETF基金的基金经理。2014年10月30日起任广发百发100指数基金的基金经理。2014年12月1日起任广发中证全指医药卫生ETF基金的基金经理。2015年1月8日起任广发中证全指信息技术ETF基金的基金经理。2015年1月29日起任广发中证全指信息技术ETF联接基金的基金经理。2015年3月23日起任广发中证全指金融地产ETF基金的基金经理。2015年4月15日起任广发可选消费联接基金的基金经理。2015年5月6日起任广发医药卫生联接基金的基金经理。2015年6月25日起任广发中证全指能源ETF和广发中证全指原材料ETF基金的基金经理。2015年7月1日起任广发中证全指主要消费ETF基金的基金经理。2015年7月9日起任广发能源联接和广发金融地产联接基金的基金经理。2015年7月23日起任广发医疗指数分级基金的基金经理。2015年8月18日起任广发原材料联接和广发主要消费联接基金的基金经理。
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-

注:1."任职日期"和"离职日期"指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内,基金运作合法合规,无损害基金持有人利益的行为,基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系,加强交易分配环节的内部控制,并通过实时的行为监控与及时的分析评估,保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面,公司制度规定投资组合投资的股票必须来源于备选股票库,重点投资的股票必须来源于核心股票库。公司建立了严格的投资授权制度,投资组合经理在授权范围内可以自主决策,超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中,中央交易部按照"时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡"的原则,公平分配投资指令。监察稽核部风险控制司通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警,实现投资风险的事中风险控制;稽核司通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核,实现投资风险的事后控制。

本报告期内,上述公平交易制度总体执行情况良好,不同的投资组合受到了公平对待,未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司原则上禁止不同投资组合之间(完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的投资组合除外)或同一投资组合在同一交易日内进行反向交易。如果因应对大额赎回等特殊情况需要进行反向交易的,则需经公司领导严格审批并留痕备查。

本报告期内,本投资组合与本公司管理的其他投资组合发生过同日反向交易的情况,但成交较少的单边交易量不超过该证券当日成交量的5%。这些交易不存在任何利益输送的嫌疑。

4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

(1)投资策略

作为ETF联接基金,本基金将继续秉承指数化被动投资策略,积极应对成份股调整、基金申赎赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击,进一步降低基金的跟踪误差。

(2)运作分析

报告期内,本基金跟踪误差来源主要是建仓、申购、赎回和成份股调整因素。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,其净值增长率为24.94%,同期业绩比较基准收益率为26.76%。

4.5管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4季度,市场恐慌情绪得到缓解,沪深两市飘红,出现了较大涨幅。2016年初,政府出台了"供给侧改革"的政策,说明政府不仅通过刺激需求的方式来激活经济,而且是通过更多样的手段实现经济的有效升级。随着国内房地产的调控与人民币升值的影响,投资与出口在我国经济增长的作用逐步减弱,经济增长方式逐步从投资驱动转向消费驱动,这是大势所趋,而随着居民收入的提高,改善型消费品的需求旺盛,可选消费品增速明显高于必需消费品,结合政府的宏观政策,可以预见,未来可选消费的发展速度应该高于全市场的发展速度。

§5投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	499,094,355.06	99.59
	其中:股票	499,094,355.06	99.59
2	固定收益投资	182,900.00	0.04
	其中:债券	182,900.00	0.04
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,805,969.66	0.36
7	其他各项资产	62,322.02	0.01
8	合计	501,145,546.74	100.00

注:上表中的股票投资项含可退替代款估值增值,而5.2的合计项不含可退替代款估值增值。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,513,890.00	0.30
B	采矿业	-	-
C	制造业	304,330,052.43	60.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	65,736,622.52	13.14
G	交通运输、仓储和邮政业	1,034,192.45	0.21
H	住宿和餐饮业	4,541,586.29	0.91
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,162,352.89	5.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	5,351,725.28	1.07
L	租赁和商务服务业	28,868,692.76	5.77
M	科学研究和技术服务业	407,040.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	9,569,129.40	1.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	880,308.00	0.18
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	47,698,763.04	9.53
S	综合	-	-
	合计	499,094,355.06	99.74

5.2.2报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	816,988	18,259,681.80	3.65
2	600104	上汽集团	561,534	11,915,751.48	2.38
3	000333	美的集团	362,168	11,886,353.76	2.38
4	600637	东方明珠	280,221	10,617,573.69	2.12
5	002024	苏宁云商	752,042	10,114,964.90	2.02
6	600978	宜华木业	351,924	7,858,462.92	1.57
7	300027	华谊兄弟	160,937	6,675,666.76	1.33
8	000625	长安汽车	383,100	6,501,207.00	1.30
9	002594	比亚迪	97,419	6,273,783.60	1.25
10	000100	TCL集团	1,450,155	6,177,660.30	1.23

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	182,900.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	182,900.00	0.04

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	123001	蓝标转债	1,829	182,900.00	0.04

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有股指期货。

(2)本基金本报告期内未进行股指期货交易。

5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(1)本基金本报告期末未持有国债期货。

(2)本基金本报告期内未进行国债期货交易。

5.11投资组合报告附注

5.11.1本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2报告期内本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	62,118.74
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	203.28
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,322.02

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600978	宜华木业	7,858,462.92	1.57	重大事项

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	322,156,094.00
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	50,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	272,156,094.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内,基金管理人不存在运用固有资金(认)申购、赎回或买卖本基金的情况。

§8备查文件目录

8.1备查文件目录

(一)中国证监会批准广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

(二)《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

(三)《广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

(四)法律意见书

(五)基金管理人业务资格批件、营业执照

(六)基金托管人业务资格批件、营业执照

8.2存放地点

广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

8.3查阅方式

1.书面查阅:查阅时间为每工作日8:30-11:30,13:30-17:00,投资者可免费查阅,也可按工本费购买复印件;

2.网站查阅:基金管理人网址:http://www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司
二〇一六年一月二十日

广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一六年一月二十日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国银行股份有限公司